

清水源-诺亚1期证券投资基金 2020 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	清水源-诺亚1期证券投资基金
基金编码	S37977
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2015年7月1日
基金管理人	深圳清水源投资管理有限公司
基金托管人（如有）	中信证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	292.143502
基金到期日期	9999年12月31日

1.2 基金产品说明

投资目标	本基金在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配置，在降低市场风险的同时追求更高收益。
业绩比较基准（如有）	本基金的业绩比较基准为沪深300指数。
风险收益特征	本基金具有中高收益、中高风险的特征。

1.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	深圳清水源投资管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名 田建	杨军智
	联系电话 0755-83453162	95548-3
	电子邮箱 tianjian@qsyfunds.com	cust_serv@citics.com
传真	0755-82028895	010-60834004
注册地址	深圳市福田区福田街道福安社区民田路178号华融大厦5层501	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	深圳市福田区福田街道福安社区民田路178号华融大厦5层501	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
邮政编码	518000	100026
法定代表人	冯文光	张佑君

1.4 信息披露方式

管理人按照相关法律法规规定定期披露产品月报、季报、年报。同时，及时披露合同约定的临时报告。

1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	中信中证投资服务有限责任公司	深圳市福田区中心三路8号 中信证券大厦21楼
外包机构	中信中证投资服务有限责任公司	深圳市福田区中心三路8号 中信证券大厦21楼

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：元

期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	-225,837.35	-161,702.16	-2,361.92
本期利润	908,463.74	1,598,468.29	-2,774,002.06
期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	-277,544.94	-446,272.94	-1,694,575.64
期末可供分配基金份额利润	-0.095	-0.088	-0.211
期末基金净资产	4,344,958.95	5,234,551.55	6,355,000.90
报告期末单位净值	1.487	1.033	0.789
累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率(%)	48.70	3.30	-21.10

√无分级□二级 □三级

2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率 (%)	净值增长率标准差 (%)	业绩比较基准收 益率(%)	业绩比较基准收 益率标准差(%)
当年	43.95			
自基金合同 生效起至今	48.70			

2.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：元

年度	每份基金份额分红 数	现金形式发放总 额	再投资形式发放 总额	年度利润分 配合计	备注
2020	0.000	0.00	0.00	0.00	
2019	0.000	0.00	0.00	0.00	

2018	0.000	0.00	0.00	0.00	
------	-------	------	------	------	--

3、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	506.83072
报告期期间基金总申购份额	0
减：报告期期间基金总赎回份额	214.687218
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	292.143502

4、管理人说明的其他情况

本产品投资经理为冯文光和吴伟。

冯文光简介如下：

中山大学金融学硕士，14 年基金从业经验，曾在诺安基金、金鹰基金、大成基金任职，多年担任基金经理。拥有丰富的基金管理经验，经历市场牛熊历练，业绩优异。所管理基金在 2013、2014 年度晨星基金评级龙虎榜中排名前 1/5，2016 年度银河证券公募基金评级榜单中同类基金业绩排名第 1；管理过基金获得“五年期金牛基金奖”、“一年期金牛基金奖”等多项大奖。

吴伟简介如下：

吴伟，毕业于清华大学会计系，13 年房地产行业研究经验，曾就职于中航证券，兴业证券国际研究部，行业研究深入，曾为大型集团公司地产业务提供战略咨询，熟悉中港两地资本市场，精于基本面分析，挖掘出多个优秀标的。现担任我司研究副总监。

5、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金的管理人在本基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由本基金管理人编制并经托管人复核审查的有关本基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	2,933.95	614.72
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	23,509.58	0.00
应收利息	0.22	0.11
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	4,360,265.50	5,258,694.37
资产总计	4,386,709.25	5,259,309.20
负债和所有者权益	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	40,789.54	23,453.93
应付托管费	479.98	651.46
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	480.78	652.26
负债合计	41,750.30	24,757.65
所有者权益：		
实收基金	2,921,435.02	5,068,307.20
未分配利润	1,423,523.93	166,244.35
所有者权益合计	4,344,958.95	5,234,551.55

负债和所有者权益总计	4,386,709.25	5,259,309.20
------------	--------------	--------------

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
一、收入	1,178,038.83	1,723,282.45
1. 利息收入	101.68	6.15
其中：存款利息收入	101.68	6.15
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	0.00	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
其中：股票投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	1,134,301.09	1,760,170.45
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以“-”填列）	43,636.06	-36,894.15
减：二、费用	269,575.09	124,814.16
1. 管理人报酬	265,895.07	118,125.28
其中：固定管理费	65,181.23	118,125.28
业绩报酬	200,713.84	0.00
2. 托管费	1,810.51	3,281.25
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	1,810.51	3,281.25
5. 交易费用	0.00	0.00
6. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
7. 其他费用	59.00	126.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	908,463.74	1,598,468.29
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	908,463.74	1,598,468.29

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,068,307.20	166,244.35	5,234,551.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	908,463.74	908,463.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,146,872.18	348,815.84	-1,798,056.34
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	-2,146,872.18	348,815.84	-1,798,056.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,921,435.02	1,423,523.93	4,344,958.95
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	8,049,576.54	-1,694,575.64	6,355,000.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	1,598,468.29	1,598,468.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,981,269.34	262,351.70	-2,718,917.64
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	-2,981,269.34	262,351.70	-2,718,917.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	5,068,307.20	166,244.35	5,234,551.55

7、期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	2,933.95
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	
	其中：优先股	
	其他股权类投资	
上市公司定向增	上市公司定向增发股票	

发投资	投资	
新三板投资	新三板挂牌企业投资	
境内证券投资规模	结算备付金	0
	存出保证金	
	股票投资	
	债券投资	
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	
	其中：信用债	
	资产支持证券	
	基金投资（公募基金）	
	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	
	买入返售金融资产	0
	其他证券类标的	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	
	信托计划投资	
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	
	保险资产管理计划投资	
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	
	私募基金产品投资	S34046#4360265.50;
	未在协会备案的合伙企业份额	
另类投资	另类投资	
境内债权类投资	银行委托贷款规模	
	信托贷款	
	应收账款投资	
	各类受（收）益权投资	
	票据（承兑汇票等）投资	
	其他债权投资	
境外投资	境外投资	
其他资产	其他资产	应收利息#0.22；证券清算款#23509.58；
基金负债情况	债券回购总额	
	融资、融券总额	
	其中：融券总额	
	银行借款总额	

	其他融资总额	
--	--------	--

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	0.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	0.00	0.00

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
合计	0.00	0.00

8、信息披露报告

此处请上传管理人向投资者披露的信息披露报告 pdf 文件，需加盖管理人公章。

请点击工具栏上“附件列表”按钮上传附件。

信息披露报告是否经托管机构复核：是